

**INFORMACJA DLA KLIENTA ALTERNATYWNEGO FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO  
ROCKBRIDGE FUNDUSZ INWESTYCYJNY ZAMKNIĘTY BEZPIECZNA INWESTYCJA 5**

**sporządzona na dzień 31 grudnia 2018 r. za okres sprawozdawczy 1 stycznia – 31 grudnia 2018 r.**

Niniejsza informacja sporządzona jest w związku z art. 222 b ustawy z dnia 27 maja 2004 r. o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (tj. Dz. U. z 2016 r., poz. 1896 z późn. zm.; „Ustawa”)

| Zakres informacji  | Termin udostępnienia   | Sposób udostępnienia  |
|--|--|---|
| Towarzystwo, na podstawie art. 222b Ustawy z uwzględnieniem art. 108 i art. 109 Rozporządzenia 231/2013 <sup>1</sup> , udostępnia informacje o:<br>a) udziale procentowym aktywów, które są przedmiotem specjalnych ustaleń w związku z ich nie płynnością,<br>b) zmianach regulacji wewnętrznych dotyczących zarządzania płynnością,<br>c) aktualnym profilem ryzyka oraz systemach zarządzania ryzykiem stosowanych przez podmiot nim zarządzający;<br>d) łącznej wysokości zastosowanej dźwigni finansowej AFI. | Informacje te udostępniane są w terminach publikacji rocznych i półrocznych sprawozdań finansowych Funduszu. | Informacje udostępniane są na stronie internetowej <a href="http://www.rockbridge.pl">www.rockbridge.pl</a>                           |
| Towarzystwo, na podstawie art. 222b Ustawy z uwzględnieniem art. 108 i art. 109 Rozporządzenia 231/2013, udostępnia informacje o:<br>a) zmianach maksymalnego poziomu Dźwigni finansowej AFI, który może być stosowany w imieniu Funduszu, oraz<br>b) prawie do ponownego wykorzystania zabezpieczeń lub gwarancji udzielonej na podstawie porozumienia dotyczącego Dźwigni finansowej AFI.  | Informacje te udostępniane są niezwłocznie po wystąpieniu zmiany.  | Informacje udostępniane są w trybie aktualizacji IDK na stronie internetowej <a href="http://www.rockbridge.pl">www.rockbridge.pl</a> |

**Procentowy udział aktywów, które są przedmiotem specjalnych ustaleń w związku z ich nie płynnością**

W Funduszu nie obowiązują specjalne ustalenia w związku z nie płynnością aktywów, tj. szczególnie uprawnienia dla inwestorów, regulujące w sposób odmienny uprawnienie do umorzenia certyfikatów na wypadek nie płynności aktywów Funduszu.

<sup>1</sup> Rozporządzenie Delegowane Komisji (UE) Nr 231/2013 z dnia 19 grudnia 2012 r. uzupełniające dyrektywę Parlamentu Europejskiego i Rady 2011/61/UE w odniesieniu do zwolnień, ogólnych warunków dotyczących prowadzenia działalności, depozytariuszy, dźwigni finansowej, przejrzystości i nadzoru (Dz. Urz. UE L 176 z 10.07.2010, str. 1).

## **Informacja o zmianach regulacji wewnętrznych dotyczących zarządzania płynnością**

W okresie sprawozdawczym wewnętrzne regulacje dotyczące zarządzania płynnością Funduszu nie podlegały zmianom.

## **Aktualny profil ryzyka oraz informacja o systemie zarządzania ryzykiem stosowanym przez Towarzystwo**

Aktualny profil ryzyka określono na 3 w siedmiostopniowej skali i stanowi on ogólny wskaźnik ryzyka i zysku ustalany zgodnie z metodologią określoną dla danych przedstawianych w Dokumentie Zawierającym Kluczowe Informacje o Funduszu (KIID).

Towarzystwo identyfikuje i stosuje limity inwestycyjne dla w szczególności następujących ryzyk:

- 1) ryzyko rynkowe (limity dla każdego czynnika ryzyka);
- 2) ryzyko kredytowe i kontrahenta;
- 3) ryzyko płynności

odpowiednio do stosowanej przez Fundusz polityki inwestycyjnej i zgodnie z metodykami określonymi w wewnętrznych procedurach.

Ryzyko operacyjne zarządzane jest globalnie na poziomie procesowym.

Globalny poziom ryzyka określany jest przez ekspozycję AFI zgodnie z zapisami Rozporządzenia 231/2013. Limit ekspozycji AFI wyznaczonej metodą zaangażowania wynosi 400% WAN Funduszu.

## **Łącznej wysokości zastosowanej dźwigni finansowej AFI na dzień bilansowy**

Łączna ekspozycja wyznaczona metodą zaangażowania wyniosła dzień 31 grudnia 2018 r. 100% WAN Funduszu.

Fundusz na dzień bilansowy nie stosował dźwigni finansowej.

Warszawa, 12 kwietnia 2019 r.

**Tomasz Stadnik**

Prezes Zarządu

**Witold Chuć**

Wiceprezes Zarządu

**Ireneusz Fafara**

Członek Rady Nadzorczej  
delegowany do czasowego  
wykonania czynności  
Członka Zarządu